



短期市場の推移

	6月21日	6月22日	6月23日	6月24日
加重平均金利	▲0.026	▲0.029	▲0.028	▲0.028
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.085	▲0.086
無コール残	141,708	153,576	141,330	143,097
ON	81,517	92,955	79,239	82,206
その他	60,191	60,621	62,091	60,891
有コール残	20,373	20,216	21,258	20,357

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表
 ※加重平均金利は無担保コールONのもの、無有コール残は無担保・有担保コール残高の意
 本日の短期市場金利 [%]

	無担保コール(速報)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.075	0.001	▲0.029	▲0.084
T/N	▲0.012	▲0.001	▲0.003	▲0.085
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	-	-	▲0.005	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.089
3W	-	-	-	▲0.092
1M	-	-	▲0.025	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.129

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

6月28日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	金融政策決定会合における 主な意見 (6月17・18日分)	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

3日積みとなる本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.015%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.029%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.055 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向は変わらず、出合水準は本日対比で横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月25日	6月28日	6月28日	6月29日	6月29日	6月29日
券	▲1,000	▲400	▲400	▲600	▲600	▲600
財政	+1,000	▲9,600	▲9,600	+6,000	+6,000	+6,000
過不足	+0	▲10,000	▲10,000	+5,400	+5,400	+5,400
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
CP等買入	▲900		▲500			
社債等買入	▲200					
国債補完供給		▲100	+100			
新型コロナ対応金融支援特別	▲99,700	+107,800				
当座預金増減	+6,900	▲10,400	▲10,400	+5,400	+5,400	+5,400
当座預金残高	5,358,200	5,347,800	5,347,800	5,353,200	5,353,200	5,353,200
準備預金残高	4,710,600					
積み終了先	4,710,200					
超過準備	4,710,200					
非準備先残高	647,600					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	40.0%					
乖離率	59.9%					

6月25日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

CP等買入(6/30~)	5,000	6,873	4,974	▲0.010	▲0.004	93.7
国債補完供給(6/25~6/28)	93	93	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
6月24日時点 6,564,700

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,632,600
6月28日以降の残り所要	
積数	2,000
平均	100

国庫短期証券入札予定

7月2日	3ヶ月 第1005回
7月8日	6ヶ月
7月9日	3ヶ月
7月15日	3ヶ月

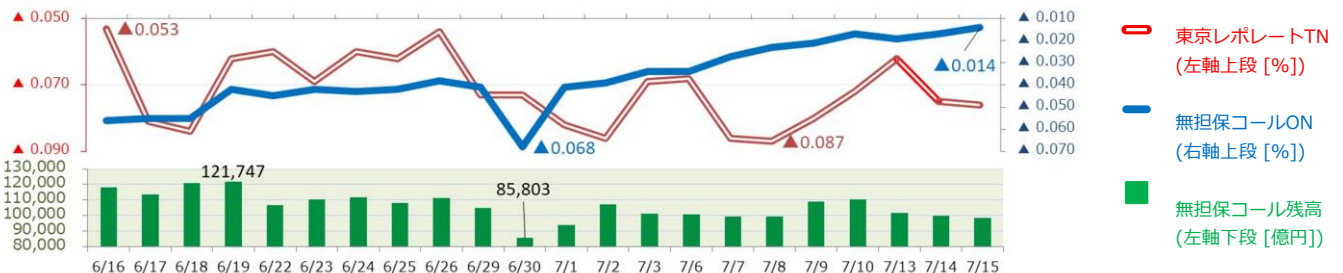
今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	1500	1,500	月1回程度	6月23日	0
1年超3年以下	4750	4,750	2 9 16 23	6月23日	0
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 16 28	6月16日	1
5年超10年以下	4500	4,500	9 16 23 28	6月23日	1
10年超25年以下	2000	2,000	2	6月2日	0
25年超	500	500	28	5月20日	1
物価連動債	600	600	月1回程度	6月9日	0
変動利付債<四半期>	300	300	-	4月21日	-

1年前の市場推移

○2020年6月積み期 [6月16日~7月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会